



COLRVL COMPASS INVESTMENTS VEINTE, S.A. DE C.V. Fondo de Inversión de Renta Variable
CARTERA DE VALORES AL 02 MAYO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
ACCIONES DE BANCOS						
41	BBAJIO	O	ALTA	40,009	2,634,992.74	2.01
ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS						
1	WALMEX	*	ALTA	238,559	15,146,110.91	11.54
1	GFNORTE	O	ALTA	62,437	10,776,626.20	8.21
1	FEMSA	UBD	ALTA	53,285	10,617,569.10	8.09
1	AMX	B	ALTA	550,018	8,833,289.08	6.73
1	GMEXICO	B	ALTA	77,218	8,123,333.60	6.19
1	CEMEX	CPO	ALTA	510,149	6,790,083.19	5.18
1	GRUMA	B	ALTA	17,593	5,936,054.13	4.52
1	MEGA	CPO	ALTA	104,958	5,310,874.80	4.05
1	BOLSA	A	ALTA	161,883	5,270,910.48	4.02
1	CUERVO	*	ALTA	135,075	4,583,094.75	3.49
1	ENTERA	*	ALTA	169,106	4,576,008.36	3.49
1	KIMBER	A	ALTA	109,059	3,982,834.68	3.04
1	LIVEPOL	C-1	ALTA	28,264	3,869,906.88	2.95
1	HCITY	*	MEDIA	837,185	3,733,845.10	2.85
1	GCC	*	ALTA	19,138	3,707,796.12	2.83
1	ASUR	B	ALTA	6,091	3,482,041.97	2.65
1	GAP	B	ALTA	8,859	2,763,653.64	2.11
OTROS TIPO DE VALOR 1 - ACCIONES INDUSTRIALES COMERCIALES Y DE SERVICIOS				1,101,588	14,523,544.70	11.07
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					124,662,570.43	95.02
REPORTO						
LF	BONDEF	260226	mxAAA	39,373	3,933,103.84	3.00
TOTAL REPORTO					3,933,103.84	3.00
OTROS VALORES				124,547	2,599,295.89	1.98
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					131,194,970.16	100.00

CALIFICACIÓN	CATEGORÍA	VaR Promedio	Límite de VaR
NA	RVESACC	1.495%	2.600%

El Fondo de inversión no se encuentra en una estrategia temporal de inversión

La metodología de cálculo del VaR utilizada es el modelo paramétrico de volatilidad estable. Un modelo paramétrico lineal calcula el VAR usando formulas analíticas basadas en una distribución paramétrica para los rendimientos de los factores de riesgo, cuando el valor de la cartera es una función lineal de sus factores de riesgo.